

# 圆信永丰优加生活股票型证券投资基金

## 2018年第四季度报告

报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	851,539,346.82	77.48
2	其中:股票	851,539,346.82	77.48
3	债券投资	27,460,573.94	2.48
4	其中:国债	27,460,573.94	2.48
5	货币资金	207,460,573.94	18.80
6	其中:银行存款	207,460,573.94	18.80
7	买入返售金融资产	130,000,000.00	11.85
8	其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产	130,000,000.00	11.85
9	其他资产	1,100,000,000.00	99.19
10	合计	1,309,560,494.70	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	12,345,678	12,345,678	0.90
B	制造业	33,333,333	33,333,333	2.50
C	建筑业	567,890,123	567,890,123	43.20
D	电力、热力、燃气及生产供应业	90,123,456	90,123,456	6.90
E	建筑业	21,234,567	21,234,567	1.60
F	批发和零售业	15,678,901	15,678,901	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	10,123,456	10,123,456	0.75
H	信息传输和金融业	10,123,456	10,123,456	0.75
I	房地产业	10,123,456	10,123,456	0.75
J	采矿业	10,123,456	10,123,456	0.75
K	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
L	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
M	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
N	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
O	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
P	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
Q	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
R	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
S	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
T	制造业	10,123,456	10,123,456	0.75
合计		851,539,346.82	851,539,346.82	63.20

#### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	1,000,000	60,775,400.00	4.68
2	000002	万科A	1,000,000	50,000,000.00	3.85
3	000003	招商银行	5,000,000	41,400,000.00	3.20
4	000066	中国石化	1,000,000	36,000,000.00	2.80
5	000012	格力电器	2,000,000	36,742,200.00	2.81
6	000009	中信证券	1,000,000	35,000,000.00	2.70
7	000001	平安银行	2,000,000	30,222,120.00	2.35
8	000066	中国石化	1,000,000	30,000,000.00	2.32
9	000002	万科A	2,000,000	30,000,000.00	2.32
10	000003	招商银行	1,000,000	30,000,000.00	2.32
11	000001	平安银行	2,000,000	30,000,000.00	2.32
12	000002	万科A	2,000,000	30,000,000.00	2.32
13	000003	招商银行	2,000,000	30,000,000.00	2.32
14	000001	平安银行	2,000,000	30,000,000.00	2.32
15	000002	万科A	2,000,000	30,000,000.00	2.32
16	000003	招商银行	2,000,000	30,000,000.00	2.32
17	000001	平安银行	2,000,000	30,000,000.00	2.32
18	000002	万科A	2,000,000	30,000,000.00	2.32
19	000003	招商银行	2,000,000	30,000,000.00	2.32
20	000001	平安银行	2,000,000	30,000,000.00	2.32

#### 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111810001	18国债01	1,000,000	95,422,450.00	6.86
2	111810002	18国债02	1,000,000	95,422,450.00	6.86
3	111810003	18国债03	1,000,000	95,422,450.00	6.86
4	111810004	18国债04	1,000,000	95,422,450.00	6.86
5	111810005	18国债05	1,000,000	95,422,450.00	6.86
6	111810006	18国债06	1,000,000	95,422,450.00	6.86
7	111810007	18国债07	1,000,000	95,422,450.00	6.86
8	111810008	18国债08	1,000,000	95,422,450.00	6.86
9	111810009	18国债09	1,000,000	95,422,450.00	6.86
10	111810010	18国债10	1,000,000	95,422,450.00	6.86
11	111810011	18国债11	1,000,000	95,422,450.00	6.86
12	111810012	18国债12	1,000,000	95,422,450.00	6.86
13	111810013	18国债13	1,000,000	95,422,450.00	6.86
14	111810014	18国债14	1,000,000	95,422,450.00	6.86
15	111810015	18国债15	1,000,000	95,422,450.00	6.86
16	111810016	18国债16	1,000,000	95,422,450.00	6.86
17	111810017	18国债17	1,000,000	95,422,450.00	6.86
18	111810018	18国债18	1,000,000	95,422,450.00	6.86
19	111810019	18国债19	1,000,000	95,422,450.00	6.86
20	111810020	18国债20	1,000,000	95,422,450.00	6.86

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	黄金	1,000,000	60,775,400.00	4.68
2	000002	白银	1,000,000	50,000,000.00	3.85
3	000003	铂金	1,000,000	41,400,000.00	3.20
4	000004	钯金	1,000,000	36,000,000.00	2.80
5	000005	铑金	1,000,000	36,742,200.00	2.81
6	000006	铱金	1,000,000	35,000,000.00	2.70
7	000007	钌金	1,000,000	30,222,120.00	2.35
8	000008	钴金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
9	000009	镍金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
10	000010	铜金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
11	000011	锌金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
12	000012	锡金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
13	000013	铅金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
14	000014	铝金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
15	000015	铁金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
16	000016	锰金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
17	000017	铬金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
18	000018	镍金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
19	000019	铜金	1,000,000	30,000,000.00	2.32
20	000020	锌金	1,000,000	30,000,000.00	2.32

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	权证A	1,000,000	60,775,400.00	4.68
2	000002	权证B	1,000,000	50,000,000.00	3.85
3	000003	权证C	1,000,000	41,400,000.00	3.20
4	000004	权证D	1,000,000	36,000,000.00	2.80
5	000005	权证E	1,000,000	36,742,200.00	2.81
6	000006	权证F	1,000,000	35,000,000.00	2.70
7	000007	权证G	1,000,000	30,222,120.00	2.35
8	000008	权证H	1,000,000	30,000,000.00	2.32
9	000009	权证I	1,000,000	30,000,000.00	2.32
10	000010	权证J	1,000,000	30,000,000.00	2.32
11	000011	权证K	1,000,000	30,000,000.00	2.32
12	000012	权证L	1,000,000	30,000,000.00	2.32
13	000013	权证M	1,000,000	30,000,000.00	2.32
14	000014	权证N	1,000,000	30,000,000.00	2.32
15	000015	权证O	1,000,000	30,000,000.00	2.32
16	000016	权证P	1,000,000	30,000,000.00	2.32
17	000017	权证Q	1,000,000	30,000,000.00	2.32
18	000018	权证R	1,000,000	30,000,000.00	2.32
19	000019	权证S	1,000,000	30,000,000.00	2.32
20	000020	权证T	1,000,000	30,000,000.00	2.32

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	期货代码	期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	股指期货A	1,000,000	60,775,400.00	4.68
2	000002	股指期货B	1,000,000	50,000,000.00	3.85
3	000003	股指期货C	1,000,000	41,400,000.00	3.20
4	000004	股指期货D	1,000,000	36,000,000.00	2.80
5	000005	股指期货E	1,000,000	36,742,200.00	2.81
6	000006	股指期货F	1,000,000	35,000,000.00	2.70
7	000007	股指期货G	1,000,000	30,222,120.00	2.35
8	000008	股指期货H	1,000,000	30,000,000.00	2.32
9	000009	股指期货I	1,000,000	30,000,000.00	2.32
10	000010	股指期货J	1,000,000	30,000,000.00	2.32
11	000011	股指期货K	1,000,000	30,000,000.00	2.32
12	000012	股指期货L	1,000,000	30,000,000.00	2.32
13	000013	股指期货M	1,000,000	30,000,000.00	2.32
14	000014	股指期货N	1,000,000	30,000,000.00	2.32
15	000015	股指期货O	1,000,000	30,000,000.00	2.32
16	000016	股指期货P	1,000,000	30,000,000.00	2.32
17	000017	股指期货Q	1,000,000	30,000,000.00	2.32
18	000018	股指期货R	1,000,000	30,000,000.00	2.32
19	000019	股指期货S	1,000,000	30,000,000.00	2.32
20	000020	股指期货T	1,000,000	30,000,000.00	2.32

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	国债期货A	1,000,000	60,775,400.00	4.68
2	000002	国债期货B	1,000,000	50,000,000.00	3.85
3	000003	国债期货C	1,000,000	41,400,000.00	3.20
4	000004	国债期货D	1,000,000	36,000,000.00	2.80
5	000005	国债期货E	1,000,000	36,742,200.00	2.81
6	000006	国债期货F	1,000,000	35,000,000.00	2.70
7	000007	国债期货G	1,000,000	30,222,120.00	2.35
8	000008	国债期货H	1,000,000	30,000,000.00	2.32
9	000009	国债期货I	1,000,000	30,000,000.00	2.32
10	000010	国债期货J	1,000,000	30,000,000.00	2.32
11	000011	国债期货K	1,000,000	30,000,000.00	2.32
12	000012	国债期货L	1,000,000	30,000,000.00	2.32
13	000013	国债期货M	1,000,000	30,000,000.00	2.32
14	000014	国债期货N	1,000,000	30,000,000.00	2.32
15	000015	国债期货O	1,000,000	30,000,000.00	2.32
16	000016	国债期货P	1,000,000	30,000,000.00	2.32
17	000017	国债期货Q	1,000,000	30,000,000.00	2.32
18	000018	国债期货R	1,000,000	30,000,000.00	2.32
19	000019	国债期货S	1,000,000	30,000,000.00	2.32
20	000020	国债期货T	1,000,000	30,000,000.00	2.32

#### 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名商品期货投资明细

0.0%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

**4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**

报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者资产净值低于五千万元情形。